

東京短資ティリーレポート

2025/10/6

<10月3日のマネタリーベース>

6,138,600

<10月6日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーオペ
日銀発表の日銀当座預金残高	4,927,600
前日の日銀当座預金残高-①	4,924,700
日銀当座預金残高増減前日比	+2,900

<10月6日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		
銀行券要因	+700	
財政等要因	+5,900	
資金過不足	+6,600	
金融調節		
期落	新規	
国債補完供給	+1,300	-1,000
金融調節合計		+300
当座預金増減-②		+6,900

<10月6日の日銀当座預金状況>

当座預金残高 (①+②)	4,931,600
準備預金残高	4,474,200
積み終了先	4,474,100
超過準備	4,474,100
非準備預金残高	457,400

<参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,983,200
今積み期間所要準備額(平均)	132,800
残り要積立額(積数)	100
残り要積立額(平均)	0
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	70.0
進捗率乖離幅	+29.9

<10月7日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		
銀行券要因	+500	
財政等要因	-400	
資金過不足	+100	
金融調節確定分		
期落	新規	
社債等買入	-100	
国債補完供給	+1,000	
金融調節合計		+900
当座預金増減		+1,000

<10月7日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ
(当預残493兆2,600億円)で
無担保コール0/NIは+0.471%~+0.477%
での出合いが中心か。

<10月7日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	4,977,600	+46,000
+40,000	4,972,600	+41,000
+35,000	4,967,600	+36,000
+30,000	4,962,600	+31,000
+25,000	4,957,600	+26,000
+20,000	4,952,600	+21,000
+15,000	4,947,600	+16,000
+10,000	4,942,600	+11,000
+5,000	4,937,600	+6,000
±0	4,932,600	+1,000
-5,000	4,927,600	-4,000
-10,000	4,922,600	-9,000
-15,000	4,917,600	-14,000
-20,000	4,912,600	-19,000
-25,000	4,907,600	-24,000
-30,000	4,902,600	-29,000
-35,000	4,897,600	-34,000
-40,000	4,892,600	-39,000
-45,000	4,887,600	-44,000

<10月6日 日銀オペ入札結果>

※スペースの関係上、内容を省略する場合があります。詳細は弊社HPをご参照ください。

(11:50) 国債補完供給 25/10/ 6-25/10/ 7 応札 981億 落札 981億 全取 +0.25% 平均 +0.25%

(13:50) 国債補完供給 25/10/ 6-25/10/ 7 応札 54億 落札 54億 全取 +0.25% 平均 +0.25%

8,009	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給
10/ 1~10/15	8,009.	9/30(3~5Y) 3,257.	1 3 , 5 4 6	6 2 8 , 7 6 0
		9/30(5~10Y) 3,504.	12/ 1~12/ 1 2,464.	11/17~11/17 0.
		9/30(25Y-) 751.	12/ 4~12/ 4 842.	11/18~11/17 57.
		9/30(物国) 500.	3/ 2~ 3/ 2 7,922.	2/16~ 2/16 0.
			3/ 4~ 3/ 4 830.	2/17~ 2/16 0.
			6/ 3~ 6/ 3 3,160.	5/12~ 5/12 0.
			6/ 3~ 6/ 3 2,384.	8/18~ 8/18 130.

※直近約1年分の期落ち分を記載

成長基盤強化支援米ドル特則

4,056百万ドル

0百万ドル

12/ 4~12/ 4 842.

3/ 4~ 3/ 4 830.

6/ 3~ 6/ 3 2,384.

※直近約1年分の期落ち分を記載

成長基盤強化支援米ドル特則

1 7 1 , 2 9 8

1/30~ 1/30 69,704.

7/18~ 7/21 101,594.

※直近約1週間の実施分を記載

国債買現先オペ

0

国債売現先(米ドルオペ用担保)

0

国庫短期証券買入額(月初来)

0

国債買現先オペ

0

国債売現先(米ドルオペ用担保)

0

CP買入額(月初来)

0

CP買入額(月初来)

0

ETF買入額

3 5 6 , 9 2 1

約定 23/10/ 4 701.

ETF買入額(企業支援)

1 4 , 6 2 8

約定 21/ 3/31 12.

J-REIT買入額

6 , 8 2 3

約定 22/ 6/14 12.

※直近約1週間の実施分を記載

<10月6日 日銀信用概算(除く買切)>

共通担保(全)固定 8,009 CP等買入(推定) 3,900

共通担保(全)金入 70,035 CP等買入(推定) 35,000

国債買現先 0

被災地金融機関支援 187

気候変動対応支援 171,298

成長基盤支援 12,791 手形売出 0

貸出増加支援 575,775 国債売現先 0

供給オペ合計 838,095 国債補完供給 1,035

貸出(推定) 0 国債現(米ドル担保) 0

供給額合計 838,095 吸収額合計 1,035

差し引き 837,060

※成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日が同じ場合まとめて表示しています。

ETF・J-REIT買入は、買入総額と直近の買入を表示しています。共通担保・成長基盤強化支援・貸出増加支援の各資金供給オペの貸付残高は、期日前返済による減少があるため、貸付額の合計とは必ずしも一致しません。

<10月6日のオープン市場気配レート(単位:%)>

NCD/CP現先	CPプライマリ	TBアウトライト
S/N 売気配 +0.400	1M -----	3M 買気配 +0.500
1W 売気配 +0.400	2M -----	6M 買気配 +0.600
2W 売気配 +0.400	3M +0.758000	1Y 買気配 +0.800
1M 売気配 +0.400		

<10月3日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高	増減
109,430	+4,073	
有担保	25,672	+581
無担保	83,758	+3,492

<10月6日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

	無担保コール			有担保コール			東京レポ・レート	
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比
翌日物	0.450	0.530	0.477	± 0	0.430	± 0	0.492	+0.001
トムネ							0.493	-0.001
スボネ								
1週間物							0.483	± 0
2週間物	0.470	0.475	0.473	-0.001			0.483	+0.001
3週間物							0.482	± 0
1ヶ月物							0.488	+0.002
3ヶ月物							0.556	-0.025
6ヶ月物							0.607	-0.013
1年物							0.711	-0.012

本資料は情報提供を目的としてのみ作成されたものであり、お取引の最終決定は御自身の判断でなされますようお願いいたします。

本資料に記載されている内容は、信頼できる情報源に基づき作成されたものですが、弊社はその正確性および確実性を保証するものではありません。

非上場債券(国債、CP等)を当社が相手方となりお買付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。

債券は、金利水準の変化等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。

商号等：東京短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第524号 加入協会：日本証券業協会